

DISCRECIONAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Accione			479,751,354	94.82%
1B	ANGELD	10	Media	255,607,613	50.52%
1B	DIABLOI	10	Baja	158,940,261	31.41%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	64,308,326	12.71%
1B	SMARTRC	14	Minima	895,153	0.18%
	Reportos			26,236,085	5.19%
BI	CETES	240801	AAA(mex)	26,236,085	5.19%
	TOTAL CARTERA			505,987,439	100.00%
	ACTIVO NETO			506,377,570	

Cartera al: 27/06/2024

Límite Máximo de VaR: 4.150 % Var Promedio: 0.870 %
Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y con una muestra de 252 observaciones.

"El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en éste fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimientos de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto."